

PROSPETTO DELLA COMPOSIZIONE E RENDICONTO RIEPILOGATIVO DELLE GESTIONI SEPARATE IN EURO

Periodo di osservazione: 1° Gennaio 2017 al 31 Dicembre 2017

Fondo ALFIERE		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
		Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE IMPRESA:	055		
CODICE GESTIONE:	005		
100	Obblig.ed altri titoli a reddito fisso:	583.123.232	595.100.528
101	BTP	258.503.883	336.703.657
102	CCT	-	1.649.606
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	76.324.778	73.466.217
104	Altri titoli di Stato emessi in valuta	917.876	917.823
105	Obbligazioni quotate in euro	247.376.695	173.843.077
107	Obbligazioni non quotate in euro	-	8.520.148
200	Titoli di capitale:	-	555.820
201	Azioni quotate in euro	-	555.820
300	Altre attività patrimoniali:	149.762.636	47.590.195
303	Quote di OICR	75.683.030	15.654.979
305	Liquidita'	74.079.606	31.935.216
1000	Saldo attività della gestione separata	732.885.868	643.246.543

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 16 febbraio 2018

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
Riserve matematiche	724.843.506	641.235.121
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

100	Proventi da investimenti	A	12.956.440
101	Interessi su titoli di Stato in euro		8.997.959
102	Interessi su titoli di Stato in valuta		10.820
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		3.932.584
105	Dividendi su azioni in euro		2.327
150	Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi di liquidità		12.751
200	Utili/perdite da realizza	B	958.190
201	Titoli di Stato in euro		1.420.911
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		75.334
204	Titoli obbligazionari non quotati in euro		29.852
207	Titoli azionari quotati in euro		-406.831
250	Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR		-161.076
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	13.914.630
500	Spese di revisione contabile	D	-
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	25.831
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	13.888.799
800	Giacenza media delle attività investite		691.699.949

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: **2,01%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
dal 01/02/16 al 31/01/17	1,98%	dal 01/06/16 al 31/05/17	1,98%	dal 01/10/16 al 30/09/17	1,94%
dal 01/03/16 al 28/02/17	1,96%	dal 01/07/16 al 30/06/17	1,98%	dal 01/11/16 al 31/10/17	2,01%
dal 01/04/16 al 31/03/17	2,02%	dal 01/08/16 al 31/07/17	1,98%	dal 01/12/16 al 30/11/17	2,01%
dal 01/05/16 al 30/04/17	2,02%	dal 01/09/16 al 31/08/17	1,95%	dal 01/01/17 al 31/12/17	2,01%

Fondo CBA Approdo		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
		Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE IMPRESA:	055		
CODICE GESTIONE:	007		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:	15.072.705	14.950.031
101	BTP	6.138.605	8.319.199
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	2.829.578	424.006
105	Obbligazioni quotate in euro	5.854.522	5.956.826
107	Obbligazioni non quotate in euro	250.000	250.000
300	Altre attività patrimoniali:	1.815.116	472.807
303	Quote di OICR	-	103.580
305	Liquidita'	1.815.116	369.227
1000	Saldo attività della gestione separata	16.887.821	15.422.838

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 16 febbraio 2018

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
Riserve matematiche	16.550.287	15.217.290
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

100	Proventi da investimenti	A	562.356
101	Interessi su titoli di Stato in euro		341.251
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		221.105
200	Utili/perdite da realizza	B	67.906
201	Titoli di Stato in euro		70.721
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		-309
250	Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR		-2.506
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	630.262
500	Spese di revisione contabile	D	-
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	319
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	629.943
800	Giacenza media delle attività investite		16.039.181

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: **3,93%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
dal 01/02/16 al 31/01/17	4,07%	dal 01/06/16 al 31/05/17	4,14%	dal 01/10/16 al 30/09/17	4,02%
dal 01/03/16 al 28/02/17	4,05%	dal 01/07/16 al 30/06/17	4,32%	dal 01/11/16 al 31/10/17	3,99%
dal 01/04/16 al 31/03/17	4,19%	dal 01/08/16 al 31/07/17	4,09%	dal 01/12/16 al 30/11/17	3,96%
dal 01/05/16 al 30/04/17	4,00%	dal 01/09/16 al 31/08/17	4,05%	dal 01/01/17 al 31/12/17	3,93%



HDI Assicurazioni S.p.A.

Via Abruzzi, 10 - 00187 Roma

Tel.06-42103.1 - Fax 06-42103500

Capitale Sociale € 96.000.000,00

C.F. e P.IVA 04349061004

Impresa autorizzata all'esercizio delle assicurazioni

con D.M.I.C.A. n. 19570 dell'8/6/93 (G.U. 14/6/93)

Società con unico azionista

Società Capogruppo del Gruppo Assicurativo HDI Assicurazioni

Iscritto all'Albo dei Gruppi Assicurativi al n. 015

hdi.assicurazioni@pec.hdia.it



Entra in HDI con il tuo Smartphone

Ai sensi delle disposizioni IVASS vigenti

Fondo VITABANK		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
		Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE IMPRESA:	055		
CODICE GESTIONE:	009		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:	2.569.656	2.665.714
101	BTP	1.262.620	1.359.023
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	800.336	799.991
105	Obbligazioni quotate in euro	506.700	506.700
300	Altre attività patrimoniali:	19.030	57.025
305	Liquidita'	19.030	57.025
1000	Saldo attività della gestione separata	2.588.686	2.722.739

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 16 febbraio 2018

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
Riserve matematiche	2.138.384	2.633.220
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

100	Proventi da investimenti	A	34.415
101	Interessi su titoli di Stato in euro		31.806
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		2.609
200	Utili/perdite da realizza	B	2.450
201	Titoli di Stato in euro		2.450
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	36.865
500	Spese di revisione contabile	D	-
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	-
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	36.865
800	Giacenza media delle attività investite		2.609.518

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: **1,41%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
dal 01/02/16 al 31/01/17	1,42%	dal 01/06/16 al 31/05/17	1,54%	dal 01/10/16 al 30/09/17	1,45%
dal 01/03/16 al 28/02/17	1,46%	dal 01/07/16 al 30/06/17	1,57%	dal 01/11/16 al 31/10/17	1,47%
dal 01/04/16 al 31/03/17	1,54%	dal 01/08/16 al 31/07/17	1,50%	dal 01/12/16 al 30/11/17	1,45%
dal 01/05/16 al 30/04/17	1,59%	dal 01/09/16 al 31/08/17	1,46%	dal 01/01/17 al 31/12/17	1,41%

Fondo CBA Accumulo		Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
		Importi da libro mastro 1	Importi da libro mastro 1
CODICE IMPRESA:	055		
CODICE GESTIONE:	006		
100	Obblig. ed altri titoli a reddito fisso:	420.572.633	335.774.906
101	BTP	160.033.390	192.596.214
102	CCT	48.955.537	4.548.913
103	Altri titoli di Stato emessi in euro	49.641.969	39.094.949
104	Altri titoli di Stato emessi in valuta	917.876	917.823
105	Obbligazioni quotate in euro	158.422.535	94.357.607
106	Obbligazioni quotate in valuta	851.326	-
107	Obbligazioni non quotate in euro	1.750.000	4.259.400
300	Altre attività patrimoniali:	35.407.089	13.184.352
303	Quote di OICR	13.691.951	7.343.148
305	Liquidita'	21.715.138	5.841.204
1000	Saldo attività della gestione separata	455.979.722	348.959.258

¹ al netto delle attività eventualmente iscritte, ai sensi dell'articolo 8 comma 4 del Reg. 38, nell'apposita sezione del libro mastro Redatto il 16 febbraio 2018

	Alla chiusura del periodo di osservazione (31/12/2017)	Alla chiusura del periodo di osservazione precedente (31/12/2016)
Riserve matematiche	451.718.142	347.079.549
Riserve matematiche relative a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Premi del periodo di osservazione relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-
Oneri relativi a sinistri, sostenuti nel periodo di osservazione, relativi a contratti stipulati con le controparti di cui all'articolo 5 del Regolamento ISVAP n 25/2008	-	-

* Non sono stati rilevati importi superiori alle soglie di rilevanza previste

100	Proventi da investimenti	A	7.535.182
101	Interessi su titoli di Stato in euro		5.471.496
102	Interessi su titoli di Stato in valuta		10.820
103	Interessi su titoli obbligazionari in euro		2.039.242
104	Interessi su titoli obbligazionari in valuta		7.395
150	Altre tipologie di proventi di cui: 151 Interessi di liquidità		6.229
200	Utili/perdite da realizza	B	612.610
201	Titoli di Stato in euro		192.060
203	Titoli obbligazionari quotati in euro		530.382
204	Titoli obbligazionari non quotati in euro		-9.400
250	Altre tipologie di utili/perdite di cui: 251 Quote di OICR		-100.432
300	Retrocessione di commissioni e altre utilità	C	-
400	Risultato finanziario lordo	A+B+C	8.147.792
500	Spese di revisione contabile	D	-
600	Spese per l'acquisto e la vendita di attività	E	23.434
700	Risultato finanziario netto	A+B+C-D-E	8.124.358
800	Giacenza media delle attività investite		404.053.179

Tasso medio di rendimento relativo al periodo di osservazione: **2,01%**

Tassi medi di rendimento realizzati nel periodo di osservazione					
tasso realizzato		tasso realizzato		tasso realizzato	
dal 01/02/16 al 31/01/17	1,97%	dal 01/06/16 al 31/05/17	1,90%	dal 01/10/16 al 30/09/17	1,91%
dal 01/03/16 al 28/02/17	1,95%	dal 01/07/16 al 30/06/17	1,89%	dal 01/11/16 al 31/10/17	1,97%
dal 01/04/16 al 31/03/17	1,95%	dal 01/08/16 al 31/07/17	1,86%	dal 01/12/16	